

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de octubre de 2022
Fecha de Información: 10 de octubre de 2022¹

Según el reporte de los Sistemas de Información y Registro de Operaciones sobre Divisas del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1634 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.23%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	581,3	169,0	63,9	538,6	75,1	0,0	42,7
15-35	165,7	724,2	701,4	96,0	6,8	53,7	16,0
36-60	20,1	10,5	0,0	0,0	10,5	20,1	0,0
61-90	0,8	3,3	0,0	0,0	3,3	0,8	0,0
91-180	5,1	3,5	0,0	0,0	3,5	5,1	0,0
>180	6,4	3,0	0,0	0,0	3,0	6,4	0,0
Total	779,4	913,4	765,3	634,6	102,2	86,1	58,7

^a Cifras en millones de dólares

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario ^a	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.47%	6.24%	5.22%	5.30%
15-35	6.77%	6.97%	6.70%	6.93%
36-60	—	7.21%	6.77%	6.92%
61-90	—	7.26%	6.57%	7.13%
91-180	—	7.11%	6.77%	6.91%
>180	—	7.45%	7.11%	7.22%
Total	4.62%	6.86%	5.58%	6.23%

^a Incluye solo operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

¹ A partir del 7 de diciembre se calcula este reporte incorporando la información preliminar reportada por los Sistemas de Información y Registro de Operaciones sobre divisas al Banco de la República.

² El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^ {(365 / \text{Plazo}))} - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	10 – 14 oct.				17 - 21 oct.				24 - 28 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	67	140	5776	6835	22	143	4121	4909	25	178	6133	5831
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3994	2750	0	0	2436	1147	0	0	3314	2945
Otros ^c	140	67	1289	1427	143	22	582	1061	178	25	771	1401
Total	207	207	11059	11012	165	165	7139	7117	203	203	10218	10177

^a Cifras en millones de dólares.

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.